

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2014

Fecha de Información: 12 de marzo de 2014 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1468,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	327,4	195,7	178,0	166,9	5,7	148,6	12,0
15-35	174,1	349,7	265,8	75,0	16,9	32,1	67,0
36-60	37,3	6,2	0,0	0,0	6,2	37,3	0,0
61-90	86,6	106,9	0,0	0,0	86,9	66,6	20,0
91-180	56,2	32,4	20,6	0,3	11,9	55,8	0,0
>180	120,3	99,7	72,2	82,6	2,5	12,6	25,0
Total	801,9	790,6	536,5	324,9	130,1	353,1	124,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,4 %	1,6 %	1,8 %	1,7 %
15-35	3,5 %	3,5 %	3,0 %	3,3 %
36-60	-	3,6 %	2,5 %	2,7 %
61-90	3,1 %	3,4 %	2,9 %	3,1 %
91-180	-	3,2 %	3,0 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,2 %	3,1 %	3,1 %
Total	3,4 %	2,8 %	2,3 %	2,6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	10 al 14 de marzo				17 al 21 de marzo				24 al 28 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	223	3746	3477	20	96	4253	5016	13	82	1684	2054
Intragrupoy off-shore***	0	0	1821	1068	4	0	3540	1930	0	0	1041	227
Otros	223	31	568	1590	92	20	372	1218	82	13	582	1027
Total	254	254	6135	6135	116	116	8165	8165	95	95	3308	3308

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.